

AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI

OPCVM de droit français

Société de gestion

Amundi Asset Management

Sous déléguataire de gestion comptable en titre

CACEIS Fund Administration France

Dépositaire

CACEIS BANK

Commissaire aux comptes

PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

Etat du patrimoine en EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier.	15 187 451 606,40
b) Avoirs bancaires	2 030 217 146,84
c) Autres actifs détenus par l'OPC	1 754 928 169,89
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	18 972 596 923,13
e) Passif	-11 205 508,85
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	18 961 391 414,28

* Les montants sont signés

Nombre de parts en circulation et valeur nette d'inventaire par part

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI DP	DP-C	80 270,74	1,000	80 270,74
AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI I	I-C	5 385 822 080,50	24 571,082	219 193,53
AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI Part I2-C	I2-C	9 982 565 977,16	1 001 359,501	9 969,01
AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI E	E-C	571 318 446,31	57 130,056	10 000,31
AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI P	P-C	158 907 503,15	1 591 493,635	99,85
AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI S	S-C	2 862 697 136,42	2 843 216,094	1 006,85

Eléments du portefeuille titres

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<p>A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.</p> <p>Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.</p>	78,44	78,39
<p>C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.</p>	1,66	1,66
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.</p>		
<p>E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.</p>		

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

Répartition des actifs du A), B), C), D) du portefeuille titres, par devise

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	15 187 451 606,40	80,10	80,05
TOTAL		15 187 451 606,40	80,10	80,05

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

Répartition des actifs du A), B), C), D) du portefeuille titres, par pays de résidence de l'émetteur

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
France	35,56	35,54
Royaume uni	15,22	15,21
Pays-bas	8,65	8,64
Irlande	6,60	6,59
Luxembourg	3,79	3,79
Italie	2,82	2,82
Belgique	2,34	2,34
Allemagne	2,06	2,06
Etats unis amerique	1,40	1,39
Suede	1,17	1,17
Canada	0,27	0,27
Espagne	0,18	0,18
Norvege	0,05	0,05
TOTAL	80,10	80,05

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

Répartition des autres actifs du E) du portefeuille titres, par nature

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays		
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres		
TOTAL		

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

Mouvements dans le portefeuille titres en cours de période en EUR

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	8 563 941 823,65	8 271 845 469,48
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	418 090 014,19	304 323 092,64
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		

Transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation des instruments financiers - Règlement SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

a) Titres et matières premières prêtés

Montant					
% de l'actif net*					

*% hors trésorerie et équivalent de trésorerie

b) Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et TRS exprimés en valeur absolue

Montant					
% de l'actif net					

c) 10 principaux émetteurs de garanties reçues (hors cash) pour tous les types d'opérations de financement

--	--	--	--	--	--

d) 10 principales contreparties en valeur absolue des actifs et des passifs sans compensation

--	--	--	--	--	--

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash	433,38				
Rating					
Monnaie de la garantie					
- EURO	433,38				

f) Règlement et compensation des contrats

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	

OPCVM AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois					
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an					
Ouvertes					

h) Échéance des opérations de financement sur titres et TRS ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois					
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an					
Ouvertes					

i) Données sur la réutilisation des garanties

Montant maximal (%)					
Montant utilisé (%)					
Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces en euros					

j) Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

Caceis Bank					
Titres					
Cash	433,38				

k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Titres					
Cash					

OPCVM AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

I) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC					
- Gestionnaire					
- Tiers					
Coûts					
- OPC					
- Gestionnaire					
- Tiers					

e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)

Amundi Asset Management veille à n'accepter que des titres d'une haute qualité de crédit et veille à rehausser la valeur de ses garanties en appliquant des décotes de valorisation sur les titres reçus. Ce dispositif est régulièrement revu et remis à jour.

i) Données sur la réutilisation des garanties

« La réglementation applicable aux OPCVM interdit la réutilisation par ce dernier des garanties reçues en titres. Les garanties reçues en espèces sont réinvesties dans les 5 supports suivants :

- o OPCVM monétaires court terme (tels que définis par l'ESMA dans ses orientations sur les fonds cotés et autres questions liées aux OPCVM)
- o Dépôt
- o Titres d'Etats Long Terme de haute qualité
- o Titres d'Etats Court Terme de haute qualité
- o Prises en pension »

Le montant maximal de réutilisation est de 0% pour les titres et 100% du montant reçu pour les espèces.

Le montant utilisé est de 0% pour les titres et 100% pour les espèces reçus.

k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Amundi Asset Management veille à travailler avec un nombre réduit de dépositaires, sélectionnés pour s'assurer de la bonne conservation des titres reçus et du cash.

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Dans le cadre des opérations de prêts de titres et de mise en pension, Amundi Asset Management, a confié à Amundi Intermédiation, pour le compte de l'OPCVM, les réalisations suivantes : la sélection des contreparties, la demande de mise en place des contrats de marché, le contrôle du risque de contrepartie, le suivi qualitatif et quantitatif de la collatéralisation (contrôles de dispersion, des notations, des liquidités), des pensions et prêts de titres. Les revenus résultant de ces opérations sont restitués à l'OPCVM. Ces opérations engendrent des coûts qui sont supportés par l'OPCVM. La facturation par Amundi Intermédiation ne peut excéder 50% des revenus générés par ces opérations.

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Dépôts				
DAT CASSA DI PARMA	EUR	150 000 000	150 008 333,33	0,79
TOTAL Dépôts			150 008 333,33	0,79
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
DEKABANK DEUTSCHE GIROZENTRALE ZCP 30-01-19	EUR	20 000 000	20 010 000,00	0,11
UNICREDIT BANK AG E3R+0.15% 25-10-19	EUR	150 000 000	150 180 000,00	0,79
TOTAL ALLEMAGNE			170 190 000,00	0,90
CANADA				
BANK OF MONTREAL E3R+0.5% 15-06-20	EUR	50 000 000	50 389 230,56	0,27
TOTAL CANADA			50 389 230,56	0,27
ETATS UNIS AMERIQUE				
GEN MILLS E3R+0.2% 20-03-19	EUR	50 000 000	50 082 500,00	0,26
PROLOGIS LP E3R+0.25% 29-01-20	EUR	55 000 000	55 204 050,00	0,30
UNITED TECHNOLOGIES E3R+0.15% 13-11-19	EUR	21 500 000	21 586 000,00	0,11
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			126 872 550,00	0,67
FRANCE				
BUREAU VERITAS 0.0% 29-04-19	EUR	40 000 000	40 078 000,00	0,21
FRAN E3R+0.3% 28-06-19	EUR	14 600 000	14 608 614,00	0,08
GECINA E3R+0.3% 21-02-19 EMTN	EUR	67 400 000	67 548 280,00	0,36
GECINA E3R+0.33% 21-08-19 EMTN	EUR	48 800 000	48 922 211,47	0,26
GROUPE DANONE E3R+0.15% 03-11-18	EUR	119 600 000	119 871 492,00	0,63
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 0.12% 11-04-20	EUR	44 000 000	44 086 386,67	0,23
UNIBAIL RODAMCO SE E3R+0.1% 30-05-20	EUR	100 000 000	100 350 000,00	0,53
VALEO E3R+0.25% 06-11-19 EMTN	EUR	70 000 000	70 183 680,00	0,37
TOTAL FRANCE			505 648 664,14	2,67
IRLANDE				
INTESA BANK IRELAND E3R+0.57% 23-01-19	EUR	250 000 000	250 112 597,22	1,32
INTESA BANK IRELAND ZCP 09-07-18	EUR	200 000 000	200 006 488,00	1,05
UNICREDIT BANK IRELAND PLC E3R+0.5% 22-09-18	EUR	400 000 000	400 418 998,67	2,11
TOTAL IRLANDE			850 538 083,89	4,48
ITALIE				
MERCEDES BENZ FINANCIAL SERVICES ITALIA E3R+0.3% 27-02-19	EUR	50 000 000	50 000 000,00	0,26
MERCEDES BENZ FINANCIAL SERVICES ITALIA E3R+0.35% 11-10-19	EUR	50 000 000	50 087 304,17	0,26
UBI BANCA UNIONE DI BANCHE ITALIANE E3R+0.44% STEP UP 07-11-	EUR	100 000 000	100 181 211,11	0,54

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
UBI BANCA UNIONE DI BANCHE ITALIANE E3R+0.44% STEPUP 07-11-1	EUR	35 000 000	35 010 923,89	0,18
TOTAL ITALIE			235 279 439,17	1,24
LUXEMBOURG				
INTE BANK LUXEMBOURG E3R+0.25% 25-09-19	EUR	100 000 000	100 159 000,00	0,53
INTE BANK LUXEMBOURG E3R+0.25% 26-09-19	EUR	100 000 000	100 120 000,00	0,53
INTE BANK LUXEMBOURG E3R+0.35% 13-04-20	EUR	75 000 000	75 088 118,75	0,40
INTESA BANK LUX ZCP 09-07-18	EUR	100 000 000	100 000 649,00	0,53
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 0.0% 19-02-19	EUR	100 000 000	100 227 500,00	0,52
MOHAWK CAPITAL LUXEMBOURG SA E3R+0.3% 11-09-19	EUR	32 400 000	32 444 528,29	0,17
TOTAL LUXEMBOURG			508 039 796,04	2,68
PAYS-BAS				
AKZO NOBEL NV E3R+0.2% 08-11-19	EUR	4 800 000	4 816 800,00	0,03
BMW FIN E3R+0.25% 12-06-20	EUR	100 000 000	100 290 000,00	0,52
BMW FIN E3R+0.25% 24-01-20	EUR	85 000 000	85 382 500,00	0,45
BMW FIN E3R+0.25% 27-03-20	EUR	50 000 000	50 192 500,00	0,26
ROYAL PHILIPS ELECTRONICS NV E3R+0.2% 06-09-19	EUR	8 600 000	8 625 800,00	0,05
TOTAL PAYS-BAS			249 307 600,00	1,31
ROYAUME UNI				
BARCLAYS BANK PLC ZCP 23-11-18	EUR	115 000 000	115 100 008,60	0,61
BARCLAYS BANK PLC ZCP 29-01-19	EUR	100 000 000	100 203 190,00	0,53
BARCLAYS BK E3R+0.4% 13-03-19	EUR	100 000 000	100 356 737,11	0,53
HITACHI CAPITAL UK PLC 0.0% 10-10-19	EUR	36 000 000	36 000 000,00	0,19
HSBC BK E3R+0.45% 22-05-20	EUR	196 000 000	197 423 134,22	1,04
TOTAL ROYAUME UNI			549 083 069,93	2,90
SUEDE				
SCANIA CV AB E3R+0.35% 06-09-19	EUR	14 900 000	14 939 612,06	0,08
SCANIA CV AB E3R+0.4% 23-01-20	EUR	50 000 000	50 229 900,00	0,26
TOYOTA INDUS FIN INTL AB E3R+0.175% 15-11-19	EUR	20 000 000	20 030 000,00	0,11
VOLVO TREASURY AB E3R+0.35% 12-12-18	EUR	40 000 000	40 000 547,78	0,21
TOTAL SUEDE			125 200 059,84	0,66
TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.			3 370 548 493,57	17,78
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			3 370 548 493,57	17,78
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
BAYERISCHE LANDESBANK 181018 FIX 0.29	EUR	50 000 000	50 045 749,15	0,26
COMMERZBANK AG FRANCFORT 220818 FIX 0.23	EUR	17 000 000	17 006 143,62	0,09
COMMERZBANK AG FRANCFORT 280519 FIX-0.14	EUR	86 000 000	86 109 257,36	0,45

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
LANDESBANK BADEN WUERTTEMBERG 070918 FIX -0.3	EUR	20 000 000	20 011 891,70	0,11
TOTAL ALLEMAGNE			173 173 041,83	0,91
BELGIQUE				
BNP PARIBAS FORTIS SA 030918 FIX 0.28	EUR	343 000 000	343 230 827,55	1,81
BNP PARIBAS FORTIS SA 101218 FIX 0.31	EUR	100 000 000	100 156 500,10	0,53
TOTAL BELGIQUE			443 387 327,65	2,34
ETATS UNIS AMERIQUE				
STAN BLAC DECK INC ZCP 27-07-18	EUR	25 000 000	25 005 932,31	0,13
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			25 005 932,31	0,13
FRANCE				
ALTAREA 130718 FIX 0.015	EUR	15 000 000	14 999 912,50	0,08
BARCLAYS BANQUE PLC 240818 OIS 0.19	EUR	260 000 000	259 701 902,13	1,37
BFCM (BANQUE FE 040918 OIS 0.05)	EUR	388 000 000	387 010 483,38	2,03
BFCM (BANQUE FE 050419 OIS 0.08)	EUR	300 000 000	299 825 030,33	1,58
BFCM (BANQUE FE 240818 OIS 0.07)	EUR	85 000 000	84 795 841,62	0,45
BFCM (BANQUE FED 290519 OIS 0.185)	EUR	50 000 000	50 171 515,84	0,26
BNP PARIBAS 030619 OIS 0.1	EUR	200 000 000	199 963 600,00	1,05
BNP PARIBAS 030918 OIS 0.07	EUR	100 000 000	99 770 692,17	0,53
BNP PARIBAS 070219 OIS 0.09	EUR	150 000 000	149 947 853,75	0,79
BNP PARIBAS 070619 OIS 0.12	EUR	250 000 000	249 964 561,04	1,32
BNP PARIBAS 080319 OIS 0.1	EUR	150 000 000	149 959 062,08	0,79
BNP PARIBAS 160718 OIS 0.09	EUR	208 000 000	207 463 030,61	1,09
BNP PARIBAS 211218 OIS 0.05	EUR	150 000 000	149 776 104,12	0,79
BNP PARIBAS 290818 OIS 0.07	EUR	70 000 000	69 830 308,22	0,37
BPCE OIS+0.12% 03-08-18	EUR	370 000 000	369 253 359,83	1,95
BPCE 110119 OIS 0.08	EUR	30 000 000	29 966 909,13	0,16
CAISSE CENTRALE DU CREDIT MUTUEL 301018 OIS 0.06	EUR	50 000 000	49 904 889,94	0,26
CIE GEN DES ETS MI ZCP 11-09-18	EUR	15 000 000	15 009 411,43	0,08
COFACE HOLDING 280918 FIX -0.285	EUR	60 000 000	60 043 257,53	0,32
COMP DE SAIN GOBA ZCP 01-10-18	EUR	30 000 000	30 020 773,17	0,16
CRCAM AQUITAINE 090419 OIS 0.07	EUR	20 000 000	19 986 809,15	0,11
CRCAM AQUITAINE 170519 OIS 0.09	EUR	20 000 000	19 993 636,77	0,11
CRCAM AQUITAINE 250918 OIS 0.07	EUR	20 000 000	19 955 647,68	0,11
CRCAM BRIE PICARDIE 240818 OIS 0.06	EUR	40 000 000	39 898 014,36	0,21
CRCAM DES COTES D'ARMOR 240818 OIS 0.07	EUR	20 000 000	19 950 558,28	0,11
CRCAM FINISTERE 100419 OIS 0.07	EUR	40 000 000	39 973 947,56	0,21
CRCAM NORMANDIE SEINE 070918 OIS 0.05	EUR	15 000 000	14 970 178,33	0,08
CRCAM NORMANDIE SEINE 101018 OIS 0.06	EUR	25 000 000	24 952 112,42	0,13
CRCAM NORMANDIE SEINE 270718 OIS 0.09	EUR	100 000 000	99 760 211,11	0,53

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CRCAM PYRENEES GASCOGNE 170519 OIS 0.09	EUR	30 000 000	29 990 455,15	0,16
CRED D OIS+0.17% 26-07-19	EUR	200 000 000	200 132 258,19	1,06
CRED L E3R+0.1% 02-12-19	EUR	30 000 000	29 995 458,90	0,16
CREDIT AGRICOLE SA 240818 OIS 0.06	EUR	25 000 000	24 938 774,24	0,13
CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL 040918 OIS 0.05	EUR	350 000 000	349 107 394,81	1,84
CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL 091018 OIS 0.06	EUR	250 000 000	249 457 205,14	1,32
FONC DES REGI -0,3 31-10-18	EUR	23 000 000	23 023 791,25	0,12
FONC DES REGI -0.35 18-07-18	EUR	20 000 000	20 003 697,72	0,11
GROUPE DANONE ZCP 07-08-18	EUR	20 000 000	20 006 722,28	0,11
ICADE SA ZCP 27-12-18	EUR	40 000 000	40 053 365,55	0,21
INGENICO (COMPAG 090818 FIX-0.335	EUR	12 000 000	12 004 582,26	0,06
LAPOSTE 080818 OIS 0.07	EUR	50 000 000	49 876 998,61	0,26
NATIXIS 100818 OIS 0.11	EUR	400 000 000	399 182 961,56	2,10
NATIXIS 281118 OIS 0.1	EUR	500 000 000	499 234 975,00	2,62
SCHN ELEC SE ZCP 19-07-18	EUR	100 000 000	100 019 183,39	0,53
SCHN ELEC SE ZCP 24-07-18	EUR	43 100 000	43 109 885,06	0,23
SCHNEIDER ELECTRIC SE 310718 FIX -0.33	EUR	45 000 000	45 013 211,14	0,24
SOCI DES AUTO PARI ZCP 08-08-18	EUR	10 000 000	10 003 502,97	0,05
SOCIETE GENERALE SA 200919 OIS 0.12	EUR	450 000 000	449 972 853,90	2,36
SOCIETE GENERALE 311218 OIS 0.065	EUR	250 000 000	249 807 645,00	1,32
UBISOFT ZCP 26-09-18	EUR	11 000 000	11 003 536,45	0,06
UNIBAIL RODAMCO SE ZCP 24-08-18	EUR	35 000 000	35 018 255,03	0,18
VEOL ENVI SA ZCP 11-07-18	EUR	25 000 000	25 002 794,19	0,13
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 170918 FIX -0.325	EUR	20 000 000	20 014 457,11	0,11
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 230519 FIX 0.214	EUR	45 000 000	45 088 487,66	0,24
VEOLIA ENVIRONNEMENT 051218 FIX -0.255	EUR	30 000 000	30 033 825,60	0,16
TOTAL FRANCE			6 237 915 892,64	32,90
ITALIE				
NORD EST 090818 FIX -0.129	EUR	200 000 000	200 056 255,24	1,05
UNICREDIT SPA 110119 FIX -0.27	EUR	100 000 000	100 178 897,25	0,53
TOTAL ITALIE			300 235 152,49	1,58
LUXEMBOURG				
ENEL FINANCE INTERNATIONAL SA 100519 FIX -0.07	EUR	210 000 000	210 134 333,63	1,11
TOTAL LUXEMBOURG			210 134 333,63	1,11
PAYS-BAS				
ING BANK NV 010319 OIS 0.055	EUR	150 000 000	149 846 085,00	0,79
ING BANK NV 180419 FIX 0.28	EUR	100 000 000	100 239 881,81	0,53
ING BANK NV 311218 FIX 0.31	EUR	250 000 000	250 454 331,11	1,32

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TELE EURO BV ZCP 10-07-18	EUR	4 000 000	4 000 281,29	0,02
TOTAL PAYS-BAS			504 540 579,21	2,66
ROYAUME UNI				
BARCLAYS BANK PLC ZCP 23-05-19	EUR	190 000 000	190 283 683,30	1,00
BARCLAYS BANK PLC 150519 FIX-0.2	EUR	76 000 000	76 140 640,22	0,40
BARCLAYS BANK PLC 311218 OIS 0.06	EUR	414 000 000	413 404 111,17	2,17
CRED SUIS AG LOND -0.29 12-11-18	EUR	26 000 000	26 031 469,15	0,14
CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH	EUR	100 000 000	100 101 603,13	0,53
CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH 081118 FIX -0.29	EUR	100 000 000	100 121 146,59	0,53
CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH 091118 FIX -0.29	EUR	100 000 000	100 122 065,48	0,53
LLOYDS BANK PLC 050419 OIS 0.085	EUR	267 000 000	266 857 775,33	1,40
LLOYDS BANK PLC 050619 OIS 0.1	EUR	75 000 000	74 987 424,75	0,40
LLOYDS BANK PLC 310119 FIX 0.31	EUR	200 000 000	200 424 414,73	1,06
RECKITT BENCKIS 120918 FIX-0.28	EUR	17 000 000	17 009 924,15	0,09
UBS BK OF SWITZERLAND LON 070619 FIX 0.2	EUR	250 000 000	250 592 791,45	1,32
UNICREDIT BANK AG (LONDON BRANCH) 070918 FIX 0.12	EUR	100 000 000	100 023 782,40	0,53
UNICREDIT BANK AG (LONDON BRANCH) 260918 FIX 0.18	EUR	45 000 000	45 021 180,62	0,24
UNICREDIT SPA LDN 300718 FIX 0.1	EUR	199 000 000	199 061 921,59	1,05
TOTAL ROYAUME UNI			2 160 183 934,06	11,39
SUEDE				
SVEN HAND AB ZCP 23-11-18	EUR	20 000 000	20 026 576,94	0,11
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 010219 FIX 0.3	EUR	36 000 000	36 068 772,57	0,19
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 150219 FIX -0.3025	EUR	40 000 000	40 079 964,91	0,21
TOTAL SUEDE			96 175 314,42	0,51
TOTAL Titres de créances négo. sur marchés régl. ou ass.			10 150 751 508,24	53,53
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
HENKEL AG AND CO.KGAA 130619 FIX -0.17	EUR	47 000 000	47 081 774,29	0,25
TOTAL ALLEMAGNE			47 081 774,29	0,25
ESPAGNE				
SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A 251018 FIX -0.27	EUR	33 500 000	33 534 932,59	0,18
TOTAL ESPAGNE			33 534 932,59	0,18
ETATS UNIS AMERIQUE				
UNIT TECH CORP -0,29 19-07-18	EUR	62 750 000	62 760 117,14	0,33
UNITED TECHNOLOGIES CORP 150818 FIX -0.29	EUR	50 000 000	50 018 944,29	0,26
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			112 779 061,43	0,59
IRLANDE				
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 080119 FIX -0.225	EUR	100 000 000	100 162 705,97	0,53

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
UNICREDIT BANK IRELAND PLC 110119 FIX -0.27	EUR	100 000 000	100 178 897,25	0,53
UNICREDIT BANK IRELAND PLC 270718 FIX -0.1	EUR	200 000 000	200 056 209,10	1,05
TOTAL IRLANDE			400 397 812,32	2,11
NORVEGE				
TELENOR AS ZCP 19-09-18	EUR	10 000 000	10 007 523,36	0,05
TOTAL NORVEGE			10 007 523,36	0,05
PAYS-BAS				
COOP RABO UA ZCP 18-10-18	EUR	400 000 000	400 624 670,68	2,12
EDP FINANCE BV ZCP 23-07-18	EUR	34 000 000	34 002 947,00	0,18
ING BANK NV 110419 FIX 0.28	EUR	200 000 000	200 475 123,37	1,06
ING BANK NV 301018 FIX -0.34	EUR	100 000 000	100 124 165,31	0,53
TELE EURO BV ZCP 08-08-18	EUR	32 000 000	32 011 387,09	0,17
TELE EURO BV ZCP 08-08-18	EUR	18 000 000	18 006 405,24	0,09
TELE EURO BV ZCP 08-11-18	EUR	6 000 000	6 005 284,65	0,03
TELEFONICA EUROPE BV 100718 FIX 0.3	EUR	95 000 000	95 008 714,94	0,50
TOTAL PAYS-BAS			886 258 698,28	4,68
ROYAUME UNI				
AVIVA PLC ZCP 09-11-18	EUR	22 000 000	22 026 039,67	0,12
VODAFONE GROUP PLC 040918 FIX -0.25	EUR	15 000 000	15 007 289,42	0,08
VODAFONE GROUP PLC 040918 FIX -0.27	EUR	75 000 000	75 039 280,59	0,39
VODAFONE GROUP PLC 100818 FIX -0.22	EUR	64 000 000	64 019 192,64	0,34
TOTAL ROYAUME UNI			176 091 802,32	0,93
TOTAL Titres de créances non ng. sur mar. régl. ou ass.			1 666 151 604,59	8,79
TOTAL Titres de créances			11 816 903 112,83	62,32
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
AMUNDI TRESO COURT TERME I C	EUR	20 910,002	391 922 170,75	2,07
BFT AUREUS - I2 C	EUR	55 005,473	548 721 743,87	2,89
BFT MONETAIRE COURT TERME I2 C	EUR	10 025	99 735 617,25	0,53
BFT SEQUIN ISRI2 C D SI	EUR	44 962,871	448 287 467,56	2,36
CPR CASH I SI	EUR	9	101 045 151,18	0,53
TOTAL FRANCE			1 589 712 150,61	8,38
LUXEMBOURG				
AMUNDI MONEY MARKET IV	EUR	14 867,552	14 945 129,28	0,08
TOTAL LUXEMBOURG			14 945 129,28	0,08
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			1 604 657 279,89	8,46
TOTAL Organismes de placement collectif			1 604 657 279,89	8,46

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Opérations de cession sur instruments financiers				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ENEL 4,25%03-13 EMTN SR	EUR	-40 000 000		
TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.				
TOTAL Opérations de cession sur instruments financiers				
Instruments financiers à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
OIS/0.0/FIX/-0.328	EUR	36 061 986	-10 598,61	
OIS/0.0/FIX/-0.328	EUR	55 094 701	-16 192,33	
OIS/0.0/FIX/-0.330	EUR	250 749 252	-65 761,15	
OIS/0.0/FIX/-0.333	EUR	100 228 018	-24 551,84	
OIS/0.0/FIX/-0.334	EUR	100 273 747	-23 469,69	
OIS/0.0/FIX/-0.334	EUR	100 273 747	-23 469,69	
OIS/0.0/FIX/-0.336	EUR	100 289 306	-20 183,99	
OIS/0.0/FIX/-0.337	EUR	400 000 000	-76 151,31	
OIS/0.0/FIX/-0.338	EUR	100 000 000	-20 267,23	
OIS/0.0/FIX/-0.339	EUR	200 630 593	-36 803,78	
OIS/0.0/FIX/-0.340	EUR	250 581 139	-43 412,95	
OIS/0.0/FIX/-0.345	EUR	200 202 426	-25 305,69	
OIS/0.0/FIX/-0.345	EUR	200 261 207	-27 052,52	
OIS/0.0/FIX/-0.346	EUR	47 080 926	-3 762,16	
OIS/0.0/FIX/-0.346	EUR	199 201 414	-23 331,12	
OIS/0.0/FIX/-0.347	EUR	40 122 719	-3 585,63	
OIS/0.0/FIX/-0.347	EUR	45 082 049	-4 800,82	
OIS/0.0/FIX/-0.347	EUR	64 141 503	-6 229,28	
OIS/0.0/FIX/-0.348	EUR	250 608 142	-15 753,43	
OIS/0.0/FIX/-0.349	EUR	17 039 626	-1 474,07	
OIS/0.0/FIX/-0.349	EUR	76 153 576	-5 133,56	
OIS/0.0/FIX/-0.35	EUR	190 302 793	-10 357,40	
OIS/0.0/FIX/-0.351	EUR	33 591 705	-2 414,89	
OIS/0.0/FIX/-0.351	EUR	343 973 828	-25 221,55	
OIS/0.0/FIX/-0.352	EUR	50 147 042	-2 539,38	
OIS/0.0/FIX/-0.352	EUR	200 567 829	-6 906,79	
OIS/0.0/FIX/-0.352	EUR	210 148 738	-7 391,20	
OIS/0.0/FIX/-0.353	EUR	15 037 908	-828,58	
OIS/0.0/FIX/-0.353	EUR	100 283 132	-2 744,31	
OIS/0.0/FIX/-0.353	EUR	75 204 744	-4 143,74	
OIS/0.0/FIX/-0.355	EUR	45 095 969	128,67	

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OIS/0.0/FIX/-0.355	EUR	20 060 851	-430,87	
OIS/0.0/FIX/-0.356	EUR	100 121 480	-1 332,78	
OIS/0.0/FIX/-0.358	EUR	86 121 910	2 501,14	
TOTAL Swap de taux			-538 972,53	
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-538 972,53	
TOTAL Instruments financiers à terme			-538 972,53	
Créances			259 926,86	
Dettes			-10 663 906,51	-0,06
Comptes financiers			2 030 217 146,84	10,71
Actif net			18 961 391 414,28	100,00

Amundi Asset Management, société anonyme au capital de 1 086 262 605 €.
Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 04 000 036.
Siège social : 90 boulevard Pasteur - 75 015 Paris - France - 437 574 452 RCS Paris - amundi.com